

# 信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金招募说明书摘要

基金管理人：信诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

本基金于 2013 年 12 月 20 日基金合同正式生效。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

投资有风险，投资人申购本基金时应认真阅读招募说明书。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本更新招募说明书所载内容截止日若无特别说明为 2016 年 12 月 20 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 9 月 30 日（未经审计）。

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：信诚基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

法定代表人：张翔燕

成立日期：2005 年 9 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2005】142 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

电话：（021）68649788

联系人：唐世春

股权结构：

股 东 出 资 额

（万元人民币） 出资比例(%)

中信信托有限责任公司 9800 49

英国保诚集团股份有限公司 9800 49

中新苏州工业园区创业投资有限公司 400 2

合 计 20000 100

### （二）主要人员情况

## 1. 基金管理人董事会成员

张翔燕女士，董事长，硕士学位。历任中信银行总行营业部副总经理、综合计划部总经理，中信银行北京分行副行长、中信银行总行营业总部副总经理，中信证券股份有限公司副总经济师，中信控股有限责任公司风险管理部总经理、中信控股有限责任公司副总裁、中国中信集团有限公司业务协同部主任，现任中信信托有限责任公司副董事长、中信信诚资产管理有限公司（信诚基金管理有限公司之子公司）监事。

王道远先生，董事，工商管理硕士。历任中信信托有限责任公司综合管理部总经理、信托管理部总经理、总经理助理、董事会秘书、副总经理。现任中信信托有限责任公司副总经理、董事会秘书、固有业务审查委员会主任兼天津信唐货币经纪有限责任公司董事长。

Guy Robert STRAPP 先生，董事，商科学士。历任瀚亚投资（香港）有限公司首席执行官，英国保诚集团亚洲区资产管理业务投资总裁、瀚亚投资（新加坡）有限公司首席执行官。现任瀚亚投资集团首席执行官兼瀚亚投资（香港）有限公司首席执行官。

魏秀彬女士，董事，新加坡籍，工商管理硕士。历任施罗德国际商业银行东南亚区域合规经理、施罗德投资管理(新加坡)有限公司亚太地区风险及合规总监。现任瀚亚投资首席风险官。

吕涛先生，董事，总经理，工商管理硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部总经理、中信基金管理有限公司（中信证券股份有限公司的全资子公司，2009年2月已与华夏基金管理有限公司合并）总经理、中信证券股份有限公司董事总经理、中信资产管理有限公司副总经理。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

孙麟麟先生，独立董事，商科学士。历任安永会计师事务所（香港）资产管理审计团队亚太区联合领导人，安永会计师事务所（旧金山）美国西部资产管理市场审计团队领导等职。现任 Lattice Strategies Trust 独立受托人、Nippon Wealth Bank 独立董事、Ironwood Institutional Multi Strategy Fund LLC and Ironwood Multi Strategy Fund LLC. 独立董事。

夏执东先生，独立董事，经济学硕士。历任财政部财政科学研究所副主任、中国建设银行总行国际部副处长、安永华明会计师事务所副总经理、北京天华会计师事务所首席合伙人。现任致同会计师事务所管委会副主席。

杨思群先生，独立董事，经济学博士。历任中国社会科学院财贸经济研究所副研究员，现任清华大学经济管理学院经济系副教授。

注：原“英国保诚集团亚洲区总部基金管理业务”自2012年2月14日起正式更名为瀚亚投资，其旗下各公司名称自该日起进行相应变更。瀚亚投资为英国保诚集团成员。

## 2. 监事

於乐女士，执行监事，经济学硕士。历任日本兴业银行上海分行营业管理部主管、通用电气金融财务（中国）有限公司人力资源经理。现任信诚基金管理有限公司首席人力资源官。

## 3. 经营管理层人员情况

吕涛先生，董事，总经理，工商管理硕士。历任中信证券股份有限公司资产管理部总经理、中信基金管理有限公司（中信证券股份有限公司的全资子公司，2009年2月已与华夏基金管理有限公司合并）总经理、中信证券股份有限公司董事总经理、中信资产管理有限公司副总经理。现任信诚基金管理有限公司总经理、首席执行官。

桂思毅先生，副总经理，工商管理硕士。历任安达信咨询管理有限公司高级审计员，中乔智威汤逊广告有限公司财务主管，德国德累斯登银行上海分行财务经理，信诚基金管理有限公司风险控制总监、财务总监、首席财务官、首席运营官。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席财务官。

唐世春先生，副总经理，法学硕士。历任北京天平律师事务所律师、国泰基金管理有限公

司监察稽核部法务主管、友邦华泰基金管理有限公司法律监察部总监、总经理助理兼董事会秘书；信诚基金管理有限公司督察长兼董事会秘书、中信信诚资产管理有限公司董事。现任信诚基金管理有限公司副总经理、首席市场官。

#### 4. 督察长

周浩先生，督察长，法学硕士，历任中国证券监督管理委员会主任科员、公职律师、副调研员，上海航运产业基金管理有限公司合规总监，国联安基金管理有限公司督察长。现任信诚基金管理有限公司督察长。

#### 5. 基金经理

杨旭先生，理学硕士、文学硕士。曾任职于美国对冲基金 Robust methods 公司，担任数量分析师；于华尔街对冲基金 WSFA Group 公司，担任 Global Systematic Alpha Fund 助理基金经理。2012 年 8 月加入信诚基金，历任助理投资经理、专户投资经理。现任数量投资副总监，信诚中证 500 指数分级基金、信诚沪深 300 指数分级基金、信诚中证 800 医药指数分级基金、信诚中证 800 有色指数分级基金、信诚中证 800 金融指数分级基金、信诚中证 TMT 产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚中证智能家居指数分级基金、信诚中证基建工程指数型证券投资基金（LOF）、信诚鼎利定增灵活配置混合型证券投资基金、信诚至益灵活配置混合型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

#### 6. 投资决策委员会成员

胡喆女士，总经理助理、副首席投资官、特定资产投资管理总监；

董越先生，交易总监；

张光成先生，股票投资总监、基金经理；

王睿先生，研究副总监、基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、 基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收

入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2016 年一季度末，中国建设银行已

托管 584 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、直销机构

信诚基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

法定代表人：张翔燕

客服电话：400-6660066

联系人：陈强

电话：021- 68649788

网址：www.xcfunds.com

##### 2、销售机构

###### （1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

电话：010-67596219

客服电话：95533

公司网站：www.ccb.com

###### （2）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

联系人：刘岫云

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

###### （3）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

联系人：张宏革

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

###### （4）中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座（邮编：518048）

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010—60838995

传真：0755-23835861、010-60836029

网址：<http://www.cs.ecitic.com>

(5) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层（266061）

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

联系电话：0532-85022326

客服电话：95548

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(6) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：洪诚

电话：0755-23953913

网址：<http://www.citicsf.com/>

(7) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：张鹏

联系电话：0755-82023442

客服电话：400-600-8008、95532

公司网站：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(8) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：魏明

联系电话：(010)85130579

客服电话：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(9) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

传真：(0755) 82943636

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

客服电话：95565、4008888111

(10) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号  
办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼  
法定代表人：杨德红  
联系人：朱雅岚  
电话：021-38676767

客户服务热线：400-8888-666 / 95521

(11) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层  
办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层  
法定代表人：黄耀华  
联系人：刘洋

联系电话：0755-83516289

客服电话：400-6666-888

公司网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(12) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层  
法定代表人：何如

基金业务联系人：齐晓燕

联系电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

全国统一客户服务电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(13) 海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(14) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户服务电话：4008-888-888

网站：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(15) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

联系人：周一涵

电话：021-38637436

全国免费业务咨询电话：95511-8

开放式基金业务传真：0755-82400862

全国统一总机：95511-8

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

(16) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

法定代表人：其实

电话：021-54660526

传真：021-54660501

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

客服电话：400-1818-188

(17) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号 903-906 室

法定代表人：杨文斌

联系电话：021-20613999

传真：021-68596916

公司网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

客服电话：400-700-9665

(18) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

联系电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

客服电话：4006-788-887

(19) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18F

法定代表人：王莉

联系电话：010—85650628

传真：010-65884788

官网网址：[www.licaike.com](http://www.licaike.com)

客服电话：400-920-0022

(20) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙焯

电话：021-20691832

传真：021-20691861

(21) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室



办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：张晶

电 话：021-33323998

传 真：021-33323993

网址：[fund.bundtrade.com](http://fund.bundtrade.com)

客户服务电话：400-820-2819

(22) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

电 话：0571-88911818

传 真：0571-86800423

公司网站：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

客服电话：4008-773-772

(23) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区金钟路 658 弄 2 号楼 B 座 6 楼

法定代表人：燕斌

电 话：021-51507071

传 真：021-62990063

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

客服电话：4000-466-788

(24) 北京创金启富投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

办公地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A

法定代表人：梁蓉

电 话：010-66154828

传 真：010-88067526

网址：[www.5irich.com](http://www.5irich.com)

客户服务电话：400-6262-818

(25) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

法定代表人：肖雯

电 话：020-89629021

传 真：020-89629011

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

客户服务电话：020-89629066

(26) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

电 话：021-20665952

传 真：021-22066653

网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

客户服务电话: 4008219031

(27) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

邮政编码: 116000

法定代表人: 林卓

电话: 0411-88891212

传真: 0411-84396536

客服电话: 4006411999

公司网站: [www.taichengcaifu.com](http://www.taichengcaifu.com)

(28) 上海云湾投资管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层

法定代表人: 王爱玲

电话: 021-68783068

传真: 20539999

客服电话: 400-820-1515

官网网址: [www.zhengtongfunds.com](http://www.zhengtongfunds.com)

(29) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008-1012

办公地址: 北京市海淀区丹棱街丹棱 SOHO 1008-1012

法定代表人: 赵荣春

电话: 010-59158281

传真: 010-57569671

网址: [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

客户服务电话: 400-893-6885

(30) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址: 上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

办公地址: 上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人: 陈继武

联系电话: 021-63333389

传真: 021-63332523

网站: [www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

客户服务电话: 4000178000

(31) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址: 南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址: 上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼

法定代表人: 袁顾明

电话: 021-22267995

传真: 021-22268089

网站: [www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

客户服务电话: 4009282266

(32) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室  
办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼  
法人代表：沈继伟  
联系电话：021-60195148  
传真：021—50583633  
公司网址：[www.leadbank.com.cn](http://www.leadbank.com.cn)

客服电话：400-067-6266

（33）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室  
办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室  
法定代表人：罗细安  
公司网址：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

客服电话：400-001-8811

（34）北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603  
办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603  
法定代表人：董浩  
电话：010-65409010

网址：[www.jimufund.com](http://www.jimufund.com)

客服电话：400-068-1176

（35）奕丰金融服务(深圳)有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室  
办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室  
法定代表人：TAN YIK KUAN

联系电话：021—20567288

传真：0755—21674453

公司网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

客服电话：400-684-0500

（36）北京广源达信投资管理有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室  
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层  
法定代表人：齐剑辉

传真：010-82055860

官网网址：[www.niuniufund.com](http://www.niuniufund.com)

客服电话：400-6236-060

（37）北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室  
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法人代表：李昭琛

联系电话：010-82628888

公司传真：010-62676582

官网网址：[www.xincai.com](http://www.xincai.com)

客服电话：010-62675369

（38）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 1108

法定代表人：王伟刚

联系电话：010-56282140

公司传真：010-62680827

官网网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

客服电话：400-068-1176

（39）浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

办公地址：杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人：徐黎云

联系电话：0571-88337717

公司传真：0571-88337666

官网网址：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

客服电话：400-068-0058

（40）杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20F

法定代表人：陈刚

联系电话：0571-85267500

公司传真：0571-8526 9200

官网网址：[www.cd121.com](http://www.cd121.com)

客服电话：0571-86655920

（41）北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 28 层

法定代表人：蒋煜

联系电话：010-58170949

官网地址：[www.shengshiview.com](http://www.shengshiview.com)

客服电话：400-818-8866

（42）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法人代表：张彦

联系电话：010-83363101

公司传真：010-83363072

客服电话：400-166-1188

官网网址：<http://8.jrj.com.cn/>

（43）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法人代表：陈超

联系电话：010-89189285

公司传真：010-89189566

客服电话：个人业务：95118 企业业务：400 088 8816

官网网址：<http://jr.jd.com>

基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

## （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：010-59378835

传真：010-59378839

联系人：朱立元

## （三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、孙睿

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：孙睿

## （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：赵钰

经办注册会计师：薛竞、赵钰

## 四、基金的名称

信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金

## 五、基金的类型

契约型开放式

## 六、基金的投资目标

本基金进行数量化指数投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，实现对中证 800 金融指数的有效跟踪，为投资者提供一个有效的投资工具。

## 七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 800 金融指数的成份股、备选成份股、新股（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、中期票据、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 金融指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

本基金原则上采用完全复制法跟踪指数，即原则上按照标的指数中成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。

当发生特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等），或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合：

(1)基本面替代：按照与被替代股票基本面及规模相似的原则，选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库；

(2)相关性检验：计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合，以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标，求解组合中替代股票的权重，并构建替代股组合。

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外，基金管理人还将做好培训和准备工作。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 金融价格指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为跟踪指数的股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份

额来看，信诚金融 A 份额具有预期风险、预期收益较低的特征；信诚金融 B 份额具有预期风险、预期收益较高的特征。

#### 十一、基金投资组合报告（未经审计）

本基金管理人董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同的约定，于 2016 年 10 月 25 日复核了本招募更新中的投资组合报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告的财务数据截止至 2016 年 9 月 30 日。

##### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 权益投资 2,003,142,805.00 94.67

其中：股票 2,003,142,805.00 94.67

2 固定收益投资 59,988,000.00 2.84

其中：债券 59,988,000.00 2.84

资产支持证券 --

3 贵金属投资 --

4 金融衍生品投资 --

5 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

6 银行存款和结算备付金合计 52,260,326.68 2.47

7 其他资产 521,095.36 0.02

8 合计 2,115,912,227.04 100.00

##### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

###### 1) 指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业 --

B 采矿业 --

C 制造业 --

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 --

F 批发和零售业 --

G 交通运输、仓储和邮政业 --

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 --

J 金融业 2,002,352,857.93 94.78

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 --

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 --

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --  
Q 卫生和社会工作 --  
R 文化、体育和娱乐业 --  
S 综合 --  
合计 2,002,352,857.93 94.78

2) 积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业 --  
B 采矿业 --  
C 制造业 343,496.49 0.02  
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --  
E 建筑业 45,750.11 -  
F 批发和零售业 32,547.63 -  
G 交通运输、仓储和邮政业 --  
H 住宿和餐饮业 --  
I 信息传输、软件和信息技术服务业 232,158.54 0.01  
J 金融业 135,994.30 0.01  
K 房地产业 --  
L 租赁和商务服务业 --  
M 科学研究和技术服务业 --  
N 水利、环境和公共设施管理业 --  
O 居民服务、修理和其他服务业 --  
P 教育 --  
Q 卫生和社会工作 --  
R 文化、体育和娱乐业 --  
S 综合 --  
合计 789,947.07 0.04

3) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

行业类别 公允价值（人民币） 占基金资产净值比例（%）

---  
合计 --

本基金本报告期末未持有沪港通投资的股票。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1) 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量（股） 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

1 601318 中国平安 6,864,877 234,504,198.32 11.10  
2 600016 民生银行 15,357,888 142,214,042.88 6.73  
3 601166 兴业银行 8,663,727 138,359,720.19 6.55  
4 600036 招商银行 6,700,505 120,609,090.00 5.71



5	601328	交通银行	17,848,592	98,702,713.76	4.67
6	600000	浦发银行	5,617,457	92,631,865.93	4.38
7	600837	海通证券	5,128,203	81,589,709.73	3.86
8	600030	中信证券	4,987,966	80,406,011.92	3.81
9	601288	农业银行	24,833,084	77,727,552.92	3.68
10	601169	北京银行	7,902,851	71,915,944.10	3.40

2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603816	顾家家居	5,287	130,377.42	0.01
2	603189	网达软件	3,898	105,713.76	0.01
3	600908	无锡银行	8,902	92,313.74	-
4	300541	先进数通	1,466	66,659.02	-
5	300534	陇神戎发	996	55,805.88	-

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	59,988,000.00	2.84
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
	其中：政策性金融债	--	--
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债	--	--
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	59,988,000.00	2.84

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160018	16 附息国债	18 600,000	59,988,000.00	2.84

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细  
本基金本报告期内未进行资产支持证券投资。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
本基金本报告期内未进行贵金属投资。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
本基金本报告期内未进行权证投资。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”,符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。本基金本报告期内未进行股指期货投资。

#### 2) 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

#### 10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 1) 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

##### 2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

##### 3) 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包括国债期货投资。

#### 11. 投资组合报告附注

1) 农业银行于 2016 年 1 月 23 日发布公告,农业银行北京分行票据买入返售业务发生重大风险事件,经核查,涉及风险金额为 39.15 亿元。公安机关已立案调查。

2) 对农业银行的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,我们认为,该处罚事项未对农业银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外,信诚 800 金融是指数型基金,对于农业银行的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

3) 中信证券因在融资融券业务开展过程中,存在违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”规定之嫌,于 2015 年 11 月 26 日收到中国证券监督管理委员会调查通知书(稽查总队调查通字 153121 号)。

4) 对中信证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,我们认为,该处罚事项未对中信证券的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外,信诚 800 金融是指数型基金,对于中信证券的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

5) 海通证券因涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规,于 2015 年 9 月 10 日收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书(处罚字[2015]73 号)。又因在融资融券业务中涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按规定与客户签订业务合同”的规定,于 2015 年 11 月 26 日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《调查通知书》(稽查总队调查通字 153122 号)。

6) 对海通证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该股票,我们认为,上述处罚事项未对海通证券的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。此外,信诚 800 金融是指数型基金,对于海通证券的投资是按照指数成分和权重进行相应配置。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程,符合法律法规和公司制度的规定。

7) 除此之外,其余本基金投资的前十名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查,或在报

告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8) 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

9) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 97,271.79

2 应收证券清算款 209,897.65

3 应收股利 -

4 应收利息 213,331.27

5 应收申购款 594.65

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 521,095.36

10) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

i. 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

ii. 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

12) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。基金业绩数据截至 2016 年 9 月 30 日。

(一) 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④ ①-③ ②-④

2013 年 12 月 20 日-2013 年 12 月 31 日 0.20% 0.05% 0.00% 1.61% 0.20% -1.56%

2014 年 1 月 1 日-2014 年 12 月 31 日 85.89% 1.59% 81.86% 1.65% 4.03% -0.06%

2015 年 1 月 1 日-2015 年 12 月 31 日 -11.89% 2.50% -10.01% 2.51% -1.88% -0.01%

2016 年 1 月 1 日-2016 年 9 月 30 日 -6.85% 1.38% -9.12% 1.38% 2.27% 0.00%

2013 年 12 月 20 日-2016 年 9 月 30 日 52.87% 1.92% 48.72% 1.94% 4.15% -0.02%

(二) 基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注: 本基金建仓日自 2013 年 12 月 20 日至 2014 年 6 月 20 日,建仓日结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

### 十三、费用概览

#### (一) 与基金运作有关的费用

##### 1. 基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金财产划拨支付的银行费用；
- (4) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (7) 基金的证券、期货交易费用；
- (8) 基金上市初费和上市月费；
- (9) 基金的账户开户费用、账户维护费用；
- (10) 基金合同生效后的标的指数许可使用费；
- (11) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### (1) 基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

###### (2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

###### (3) 基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人中证指数有限公司签署的指数许可使用协议的约定向中证指数有限公司支付指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的费率发生变更，本条下的指数许可使用费将相应变更，基金管理人将在更新的招募说明书或公告中予以披露。

通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元（大写：伍万元整）。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。计费区间不足一季度的，该季度指数许可使用费收取下限的计算方法如下：许可使用费的收取下限=5 万元× 本基金在本季度的实际运作天数 / 所在季度的实际天数

指数许可使用费从基金合同生效日开始每日计算，逐日累计。标的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次，基金合同生效后，由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后，于每年 1 月、4 月、7 月、10 月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司上一季度的标的指数许可使用费。

（4）除管理费和托管费、指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

### 3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

### （二）与基金销售有关的费用

1、信诚金融份额的申购费用由投资人承担，不列入基金资产，用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。信诚金融份额的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

2、根据基金合同的规定，信诚金融份额的申购费率不超过 5%，赎回费率不超过 5%。

3、信诚金融份额的场外申购费率如下：

单笔申购金额 场外申购费率

M < 50 万 1.2%

50 万 ≤ M < 200 万 0.8%

200 万 ≤ M < 500 万 0.4%

M ≥ 500 万 1000 元/笔

（注：M：申购金额；单位：元）

信诚金融份额的场内申购费率由基金代销机构参照场外申购费率执行。

为更好地满足投资者的理财需求，根据相关基金基金合同、招募说明书的有关规定，信诚基金管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自 2015 年 12 月 1 日起，针对旗下现有所有指数分级证券投资基金基础份额的场内申购费率实施费率优惠，调整后信诚中证 800 金融指数分级证券投资基金场内申购费率如下：

单笔申购金额 申购费率

M < 50 万 0

50 万 ≤ M < 200 万 0

200 万 ≤ M < 500 万 0

M ≥ 500 万 0

4、信诚金融份额的场外赎回费率按照基金份额持有时间逐级递减，场外赎回的实际执行的费率如下：

持有时间 场外赎回费率

Y < 1 年 0.5%

1年 $\leq$ Y<2年 0.25%

Y $\geq$ 2年 0

(注：Y：持有时间，其中1年为365日，2年为730日)

信诚金融份额的场内赎回费率为固定值0.5%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。

从场内转托管至场外的信诚金融份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“运作办法”）、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对原《信诚中证800金融指数分级证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分更新了相应日期。在“释义”部分更新了关于基金法的释义。
- 2、在“第三部分 基金管理人”中的“主要人员情况”部分，更新了相关成员的内容。
- 3、在“第五部分 相关服务机构”部分，根据实际情况对其他销售机构和审计基金财产的会计师事务所的相关信息进行了更新。
- 4、在“第十四部分 基金的投资”部分，更新了“基金投资组合报告”，财务数据截止至2016年9月30日。
- 5、在“第十五部分 基金的业绩”部分，更新了该节的内容，数据截止至2016年9月30日。
- 6、在“第二十八部分 其他应披露事项”部分，披露了自2016年6月21日以来涉及本基金的相关公告。

信诚基金管理有限公司

2017年1月26日